



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

Praça Dalva Paiva Ribeiro, 312 – Vila Paiva – CEP: 37.018-625 – Varginha(MG) – Fone: (35) 3221-2419

www.inprev.varginha.mg.gov.br

Relatório de Investimentos

Fevereiro/2023

O Serviço Financeiro do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Varginha – INPREV, com foco no segurado e na total transparência, apresenta o Relatório de Investimentos, relativo ao mês de fevereiro de 2023.

O objetivo é demonstrar o fechamento de fevereiro e do ano de 2023, apontando suas rentabilidades e demais informações para promoção de transparência pública, com intuito de divulgar os resultados dos investimentos dos recursos do INPREV.

O Instituto possui Comitê de Investimentos composto por 5 membros, todos habilitados com certificação de profissional de mercado CGRPPS, CPA-10 e CPA-20. O Comitê é o órgão responsável por auxiliar o Conselho Deliberativo e a Diretoria Executiva nas decisões relacionadas aos investimentos.

Os investimentos dos Regimes Próprios de Previdência Social em 2023 são regidos pela Resolução CMN nº 4.963/2021, e, a Política de Investimentos do INPREV para 2023 aprovada pelo Conselho Deliberativo.

O INPREV possui segregação de massa do seu plano de benefícios desde 28/05/2013. A Segregação de massa de segurados do Instituto é uma separação desses segurados em dois grupos distintos, a partir da definição de uma data de corte, 01/05/1994, sendo um grupo intitulado de plano financeiro e o outro de plano previdenciário.

O Plano Financeiro é um sistema estruturado somente no caso de segregação da massa, onde as contribuições a serem pagas pelo ente federativo, pelos servidores ativos e inativos e pelos pensionistas vinculados são fixadas sem objetivo de acumulação de recursos, sendo as insuficiências aportadas pelo ente federativo, admitida a constituição de Fundo Financeiro.

O Plano Previdenciário é um sistema estruturado com a finalidade de acumulação de recursos para pagamento dos compromissos definidos no plano de benefícios do INPREV, sendo o seu plano de custeio calculado atuarialmente segundo conceitos dos regimes financeiros de Capitalização, Repartição de Capitais de Cobertura e Repartição Simples.

O INPREV conta ainda com contas distintas para Taxa de Administração e Reserva Administrativa.

O INPREV nas questões relacionadas a investimentos, possui consultoria financeira contratada, assim, conta com o apoio da LDB Consultoria Financeira.

Os números e resultados apresentados aqui se referem aos valores consolidados dos Planos Previdenciário, Financeiro e, Taxa de administração e Reserva administrativa.

A carteira de investimentos do INPREV fechou o mês de fevereiro de 2023 com posição em 47 fundos de investimentos, sendo 19 em Renda Fixa, 18 em Renda Variável, 8 em Investimentos no Exterior e 2 em Multimercado, com isso procura-se evitar que a carteira esteja exposta ao mesmo tipo de risco, mercado ou indexador, buscando sempre estratégias descorrelacionadas.

As estratégias de alocação perseguida pelo INPREV estão dispostas na Política Anual de Investimentos 2023, aprovada pelo Conselho Deliberativo, que traçou as diretrizes a serem seguidas durante o exercício. A meta estabelecida para os investimentos do INPREV em 2023 é IPCA+5,17%.

O Relatório de Investimentos será apreciado pelo Comitê de Investimentos, Conselho Deliberativo e Conselho Fiscal, de modo a conter registro em suas respectivas atas de reuniões.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

Praça Dalva Paiva Ribeiro, 312 – Vila Paiva – CEP: 37.018-625 – Varginha(MG) – Fone: (35) 3221-2419

www.inprev.varginha.mg.gov.br

Cenário Econômico Fevereiro/2023

Em conformidade com o Boletim RPPS da Caixa Econômica Federal (02/2023), no cenário internacional, a Guerra na Ucrânia completou um ano e ainda sem expectativa de término. A perspectiva quanto ao crescimento econômico mundial, pelo FMI, se manteve estável (2,1% para 2023 e 2,9 para 2024). Ao passo que, houve queda na projeção da inflação de 5,2% ante 5,3% em 2023 e continuidade para 2024 (3,3%). No ambiente doméstico, em fevereiro, os indicadores de confiança foram variados: houve crescimento do comércio (+4,0%) e da construção (+0,9%), e queda na confiança do consumidor (-1,5%), da indústria (-1,2%) e dos serviços (-0,4%). Já os indicadores de atividade, divulgados em fevereiro e referentes a dezembro de 22, apresentaram a seguinte composição: o volume de serviços subiu 3,1% (M/M). A produção industrial se manteve estável, em relação a novembro (0,1%). O varejo restrito recuou 2,6% (M/M) ante -0,9% (M/M) nov/22. No mercado de trabalho, a taxa de desemprego caiu de 8,1% para 7,9%. Acerca da política fiscal, a arrecadação federal de janeiro foi de R\$ 251,7 bilhões (+1,1%, A/A real), registrando superávit primário de R\$ 99,0 bilhões. Sendo assim, a Dívida Bruta do Governo Geral (DBGG) atingiu 73,1% do PIB (R\$ 7,3 trilhões) em janeiro. Já a Dívida Líquida do Setor Público (DLSP), atingiu 56,6 do PIB (R\$ 5,6 trilhões) nesse mesmo mês. Referente à inflação, o IPCA avançou 0,84% (M/M) em fevereiro, alta em comparação com a mediana das projeções de mercado (0,78%). Sendo assim, o índice acumulou alta de 5,60 % em 12 meses. Sobre a política monetária, o COPOM decidiu manter a SELIC inalterada 13,75% a.a..Em janeiro, nos EUA, houve avanço de +0,5% (M/M) no índice de preços, com relação a dezembro. Com isso, o índice acumulado desacelerou de 6,5% para 6,4% em 12 meses. No mercado de trabalho foram criadas 517 mil vagas líquidas de emprego não agrícolas, sendo acima da expectativa do mercado, mais uma vez (190 mil). Sobre a atividade, houve alta nas vendas do varejo em 3,0% (M/M) e na produção industrial também de -1,0% (M/M) para 0,0% em janeiro. Acerca da Política Monetária, o FOMC elevou a taxa de juros em 0,25p.p, para o intervalo entre 4,50% e 4,75%. O presidente Jerome Powell afirmou que o Comitê está focado em voltar a meta da inflação a 2%, mas precisará de mais indícios para tal ação. A prévia da inflação, na Zona do Euro, desacelerou de 9,2% para 8,5% (A/A), em janeiro. Os destaques desse mês foram a “Energia” com queda de 25,7% para 17,2% e alta no grupo de “Alimentação, Bebidas e Tabaco” de 13,8% para 14,1%. Foi registrada uma queda de -1,1% (M/M) na produção industrial em dez/22. Já sobre a política monetária, o Banco central Europeu elevou suas três taxas de juros de referência em 0,50%, de acordo com a expectativa do mercado e pretende elevar em mais 0,50% (M/M) na próxima reunião, a fim de manter o processo de normalização dos juros. Além disso, o BCE vai reduzir a carteira de compra dos ativos em 15 bilhões de euro por mês. Em fevereiro, o Partido Comunista da China declarou o fim da política “COVID ZERO”, no entanto, devido ao Ano Novo Lunar Chinês, os dados relevantes referentes a fevereiro não foram divulgados. No Japão, a prévia do PIB 4T22 registrou crescimento de 0,2% (T/T), abaixo das expectativas de mercado.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

Praça Dalva Paiva Ribeiro, 312 – Vila Paiva – CEP: 37.018-625 – Varginha(MG) – Fone: (35) 3221-2419

www.inprev.varginha.mg.gov.br

Desempenho dos Investimentos	No Mês	No Ano
Meta Atuarial IPCA+5,17%	1,20%	2,19%
Rentabilidade Consolidada	(-) 0,73%	1,14%

Varição Patrimonial	Aumentativa	Diminutiva
No Mês		-3.395.858,38
No Ano	5.341.497,96	

Valor do Investimento	Em 31/01/2023	Em 28/02/2023
	R\$ 469.006.568,73	R\$ 463.868.723,95

Enquadramento Res. 4963/2021	Valor Investido	% Recursos	Limites				
			Resolução	Pró-Gestão Nível II	Política de Investimentos		
					Mínimo	Objetivo	Máximo
Art. 7º, I, a - Títulos Públicos	150.894.650,61	32,53%	100%	100%	10%	30%	100%
Art. 7º, I, b - Fundos 100% TP - Ref.	151.516.750,04	32,66%	100%	100%	10%	27%	100%
Art. 7º, III, a - Fundos Renda Fixa em Geral	33.324.735,24	7,18%	60%	70%	2%	12%	70%
Art. 7º, IV - Ativos de RF (Inst. Financeiras)	0,00	0,00%	20%	20%	0%	1%	20%
Total Renda Fixa	335.736.135,89	72,38%				70%	
Art. 8º, I - Fundos de Ações	95.882.512,92	20,67%	30%	40%	6%	17%	40%
Total Renda Variável	95.882.512,92	20,67%				17%	
Art. 9º, II - FI no Exterior	13.921.656,99	3,00%	10%	10%	0%	5%	10%
Art. 9º, III - Ações - BDR Nível I	9.231.208,83	1,99%	10%	10%	0%	2%	10%
Total Investimentos no Exterior	23.152.865,82	4,99%				7%	
Art. 10, I - Fundos Multimercados	9.097.209,32	1,96%	10%	10%	0%	5%	10%
Total Investimentos Estruturados	9.097.209,32	1,96%				5%	
Art. 12, II - Emprést. Consignado-C/ Pró Gestão	0,00	0,00%	10%	10%	0%	1%	10%
Total Investimentos Em Consignado	0,00	0,00%				1%	
Total dos Investimentos	463.868.723,95	100,00%				100%	



LDB
EMPRESAS

VARGINHA - CONSOLIDADO
FEVEREIRO 2023



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 28.02.2023.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

72,38%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,819800%)	2,90	0,07	0,96	2,15	5.016.271,36	1,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,831000%)	2,93	0,07	0,96	2,15	10.440.922,87	2,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,100000%)	3,00	0,07	0,98	2,19	10.212.889,84	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,786500%)	2,87	0,06	0,95	2,15	10.564.586,89	2,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	2,91	0,07	0,96	2,16	10.189.937,93	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,895000%)	2,93	0,07	0,96	2,16	10.430.087,74	2,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,020000%)	2,98	0,07	0,97	2,18	10.278.274,60	2,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,160000%)	4,22	0,07	0,98	2,20	10.112.119,07	2,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	4,72	0,07	0,96	2,16	10.521.013,90	2,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,783000%)	3,08	0,07	1,02	2,30	10.028.257,98	2,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,941000%)	3,09	0,07	1,03	2,32	10.407.618,58	2,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,280000%)	3,11	0,07	0,99	2,22	12.041.085,51	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,295100%)	3,10	0,07	0,99	2,22	10.332.670,20	2,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,972000%)	3,11	0,07	0,97	2,17	10.191.310,54	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,020000%)	3,06	0,07	0,97	2,18	10.127.603,61	2,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,85	0,07	0,98	2,20	150.894.650,62	32,53

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
XP	BNP PARIBAS	TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,07	0,05	0,36	0,36	4.140,01	0,00	196.383.039,77	0,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,46	-0,09	0,98	1,63	6.508.045,95	1,40	6.344.349.295,74	0,10
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,55	-0,28	1,27	1,26	39.326.459,79	8,48	5.703.776.580,01	0,69
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,64	-0,28	1,26	1,22	2.922.241,27	0,63	3.236.214.383,57	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	0,01	1,39	2,78	42.065.860,45	9,07	7.935.684.977,28	0,53
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,66	0,01	1,40	2,79	45.695.021,54	9,85	5.558.874.332,70	0,82
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,84	0,08	0,91	2,43	6.387.471,76	1,38	3.864.016.961,46	0,17
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,49	0,03	0,97	1,92	8.607.509,27	1,86	284.318.131,78	3,03
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		3,47	-0,07	1,30	2,24	151.516.750,04	32,66		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,05	0,85	1,99	29.210.849,26	6,30	13.891.144.708,98	0,21
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,05	0,85	1,89	356.682,81	0,08	3.964.919.513,24	0,01
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,76	0,03	0,87	1,91	3.757.203,17	0,81	2.496.061.867,24	0,15
	Sub-total Artigo 7º III, Alínea a		1,94	0,05	0,85	1,97	33.324.735,24	7,18		
	Renda Fixa		2,74	0,00	1,10	2,19	335.736.135,90	72,38		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

20,67%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	20,11	-0,85	-7,27	-3,80	4.508.966,59	0,97	262.678.592,44	1,72
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	19,71	-0,43	-6,90	-3,79	1.629.718,87	0,35	787.939.109,22	0,21
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,69	-0,69	-6,91	-3,78	7.487.375,33	1,61	445.758.167,51	1,68
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,85	-0,71	-7,74	-4,40	7.383.119,38	1,59	783.163.513,62	0,94
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	19,82	-1,11	-5,37	-2,86	1.237.129,85	0,27	876.824.136,01	0,14
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	22,48	-0,92	-6,29	-1,93	7.069.858,98	1,52	1.337.859.374,92	0,53
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	19,54	-0,42	-6,28	-2,98	6.705.907,12	1,45	871.759.853,34	0,77
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	19,92	-0,74	-6,70	-4,43	2.835.638,04	0,61	518.369.159,10	0,55
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	20,87	-0,62	-6,41	-3,30	6.429.910,44	1,39	361.019.606,18	1,78
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,75	-0,63	-6,44	-3,86	7.038.536,99	1,52	901.055.650,43	0,78
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	23,56	-1,19	-9,10	-5,25	6.186.791,87	1,33	358.025.193,09	1,73
XP	SANTANDER	XP INVESTOR 30 FIC FIA	20,32	-0,41	-5,66	-2,43	6.899.151,51	1,49	200.578.600,83	3,44
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	23,70	-0,50	-6,47	-3,44	5.230.496,63	1,13	782.127.879,01	0,67
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	21,26	-0,52	-7,34	-4,24	6.358.870,45	1,37	872.050.349,56	0,73
BRAM	BEM	BRANCO F I A SELECTION	21,71	-1,04	-7,48	-3,85	5.331.007,87	1,15	420.232.220,21	1,27
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	16,75	0,14	-3,21	-2,37	1.900.180,46	0,41	336.546.202,56	0,56
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	22,24	-0,82	-8,08	-1,93	5.804.861,21	1,25	857.732.577,69	0,68
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	21,98	-0,64	-6,89	-3,99	5.844.991,32	1,26	144.977.045,84	4,03
Sub-total Artigo 8º I			20,48	-0,69	-6,90	-3,51	95.882.512,91	20,67		
Renda Variável			20,48	-0,69	-6,90	-3,51	95.882.512,91	20,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,99%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
XP	BNP PARIBAS	SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FUNDO INVESTIMENTO EM COTAS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	11,34	0,03	0,37	0,37	975.562,97	0,21	239.450.300,68	0,41
BB	BB	BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	15,24	-0,71	-1,57	1,56	2.118.456,04	0,46	160.371.177,02	1,32
BB	BB	BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	21,94	0,00	0,65	0,39	1.861.166,81	0,40	84.936.575,99	2,19
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	56,04	1,17	0,71	12,18	1.502.447,33	0,32	186.017.956,94	0,81
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	28,83	-0,05	1,57	8,58	1.875.338,41	0,40	75.708.356,77	2,48
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	39,18	1,41	1,39	12,55	2.385.211,77	0,51	590.852.345,79	0,40
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	25,68	0,53	0,35	2,10	3.203.473,65	0,69	286.454.880,94	1,12
Sub-total Artigo 9º II			26,12	0,37	0,42	5,51	13.921.656,98	3,00		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	26,14	0,39	0,75	5,10	9.231.208,83	1,99	1.983.611.681,32	0,47
Sub-total Artigo 9º III			26,14	0,39	0,75	5,10	9.231.208,83	1,99		
Investimentos no Exterior			23,23	0,38	0,56	5,34	23.152.865,81	4,99		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,96%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
VINCI	BTG PACTUAL	VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	3,68	-0,17	-0,17	-0,17	898.473,87	0,19	33.589.797,89	2,67
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	23,33	-0,11	-1,87	4,43	8.198.735,48	1,77	171.224.620,27	4,79
Sub-total Artigo 10º I			23,33	-0,12	-1,88	4,43	9.097.209,35	1,96		
Investimentos Estruturados			23,33	-0,12	-1,88	4,43	9.097.209,35	1,96		
Total			6,01	-0,12	-0,73	1,14	463.868.723,97	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	150.894.650,62	32,53	10,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	151.516.750,04	32,66	10,00	27,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	33.324.735,24	7,18	2,00	12,00	70,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	335.736.135,90	72,38					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	95.882.512,91	20,67	6,00	17,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	95.882.512,91	20,67					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	13.921.656,98	3,00	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	9.231.208,83	1,99	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.152.865,81	4,99					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	9.097.209,35	1,96	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	9.097.209,35	1,96					15,00
Total		463.868.723,97	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,98 106,39	2,20 107,10	3,06 95,54	4,89 75,82		1.469.161,76	3.276.146,78
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,30 141,32	2,24 109,22	2,87 89,61	4,82 74,80	10,10 77,74	1.944.417,88	3.298.071,58
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,85 92,85	1,97 96,13	3,11 97,22	6,47 100,37	12,44 95,71	321.557,43	777.043,35
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-6,90 0,59	-3,51 0,86	-6,28 0,44	-7,35 -3,16	-8,20 -0,94	-7.107.276,20	-3.490.550,78
Artigo 9º II % do CDI	0,42 45,84	5,51 268,35	4,41 137,82	5,19 80,57	-10,01 -77,04	65.407,90	686.398,18
Artigo 9º III % do CDI	0,75 81,66	5,10 248,54	0,06 1,92	0,40 6,18	-10,41 -80,08	68.693,39	447.904,17
Artigo 10º I % do CDI	-1,88 -204,33	4,43 215,77	-0,71 -22,16	4,42 68,56	-1,46 -11,26	-157.820,53	346.484,69
VARGINHA - CONSOLIDADO (Total)						-3.395.858,37	5.341.497,97

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,819800%)	4.968.754,96	0,00	0,00	0,00	5.016.271,36	47.516,40	105.635,21
NTN-B 150535 (5,831000%)	10.341.952,88	0,00	0,00	0,00	10.440.922,87	98.969,99	220.035,31
NTN-B 150535 (6,100000%)	10.114.240,43	0,00	0,00	0,00	10.212.889,84	98.649,41	219.253,58
NTN-B 150545 (5,786500%)	10.464.760,58	0,00	0,00	0,00	10.564.586,89	99.826,31	221.946,86
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.092.945,86	0,00	0,00	0,00	10.189.937,93	96.992,07	215.624,82
NTN-B 150545 (5,895000%)	10.330.774,83	0,00	0,00	0,00	10.430.087,74	99.312,91	220.781,39
NTN-B 150545 (6,020000%)	10.179.539,51	0,00	0,00	0,00	10.278.274,60	98.735,09	219.464,08
NTN-B 150545 (6,160000%)	10.014.040,12	0,00	0,00	0,00	10.112.119,07	98.078,95	217.981,39
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.421.144,09	0,00	0,00	0,00	10.521.013,90	99.869,81	222.023,05
NTN-B 150824 (6,783000%)	10.223.166,05	0,00	0,00	297.915,14	10.028.257,98	103.007,07	230.572,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150824 (6,941000%)	10.609.438,25	0,00	0,00	309.831,74	10.407.618,58	108.012,07	241.750,97
NTN-B 150830 (6,280000%)	12.280.887,51	0,00	0,00	359.404,82	12.041.085,51	119.602,82	267.841,82
NTN-B 150832 (6,295100%)	10.539.760,44	0,00	0,00	309.831,74	10.332.670,20	102.741,50	230.098,30
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.390.163,22	0,00	0,00	297.915,14	10.191.310,54	99.062,46	221.883,49
NTN-B 150850 (6,020000%)	10.326.733,85	0,00	0,00	297.915,14	10.127.603,61	98.784,90	221.254,22
					150.894.650,62	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	6.403.771,30	41.406,12	0,00	0,00	6.508.045,95	62.868,53	104.076,01
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	38.834.296,96	0,00	0,00	0,00	39.326.459,79	492.162,83	488.080,46
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	45.363.148,96	0,00	-300.000,00	0,00	45.695.021,54	631.872,58	1.214.195,51
BB PREV RF IPCA	6.329.564,59	0,00	0,00	0,00	6.387.471,76	57.907,17	151.492,47
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	41.488.883,74	0,00	0,00	0,00	42.065.860,45	576.976,71	1.139.627,04
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.885.955,22	0,00	0,00	0,00	2.922.241,27	36.286,05	35.337,66
SANTANDER RF ATIVO FIC	8.524.486,55	0,00	0,00	0,00	8.607.509,27	83.022,72	161.941,14
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.872.818,72	-1.872.000,00	0,00	4.140,01	3.321,29	3.321,29
					151.516.750,04	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	449.781,62	4.926.468,20	-5.032.197,10	0,00	356.682,81	12.630,09	36.943,75
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.311.871,65	4.476.000,00	-5.853.668,65	0,00	29.210.849,26	276.646,26	669.719,63
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	3.724.922,09	0,00	0,00	0,00	3.757.203,17	32.281,08	70.379,97
					33.324.735,24	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	4.862.444,95	0,00	0,00	0,00	4.508.966,59	-353.478,36	-177.974,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	1.307.370,32	0,00	0,00	0,00	1.237.129,85	-70.240,47	-36.464,26
BB AÇÕES AGRO FIC FI	1.963.131,54	0,00	0,00	0,00	1.900.180,46	-62.951,08	-46.099,68
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	6.870.452,34	0,00	0,00	0,00	6.429.910,44	-440.541,90	-219.364,68
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8.002.260,54	0,00	0,00	0,00	7.383.119,38	-619.141,16	-339.545,50
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	6.315.182,75	0,00	0,00	0,00	5.804.861,21	-510.321,54	-114.468,38
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	6.862.331,34	0,00	0,00	0,00	6.358.870,45	-503.460,89	-281.863,42
BRADESCO F I A SELECTION	5.762.199,64	0,00	0,00	0,00	5.331.007,87	-431.191,77	-213.501,15
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7.544.520,43	0,00	0,00	0,00	7.069.858,98	-474.661,45	-138.880,74
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	7.155.578,74	0,00	0,00	0,00	6.705.907,12	-449.671,62	-205.776,86
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	1.750.547,16	0,00	0,00	0,00	1.629.718,87	-120.828,29	-64.285,28
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	8.042.843,75	0,00	0,00	0,00	7.487.375,33	-555.468,42	-294.144,28
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	6.806.433,68	0,00	0,00	0,00	6.186.791,87	-619.641,81	-342.898,85
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	6.277.372,65	0,00	0,00	0,00	5.844.991,32	-432.381,33	-243.024,17
OCCAM FIC FIA	7.522.915,60	0,00	0,00	0,00	7.038.536,99	-484.378,61	-282.745,63
VINCI MOSAICO FIA	5.592.303,11	0,00	0,00	0,00	5.230.496,63	-361.806,48	-186.169,54
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	3.039.171,68	0,00	0,00	0,00	2.835.638,04	-203.533,64	-131.298,27
XP INVESTOR 30 FIC FIA	7.312.728,89	0,00	0,00	0,00	6.899.151,51	-413.577,38	-172.045,68
					95.882.512,91	0,00	0,00

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	2.152.153,41	0,00	0,00	0,00	2.118.456,04	-33.697,37	32.451,78
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	1.849.143,23	0,00	0,00	0,00	1.861.166,81	12.023,58	7.307,97
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.491.830,60	0,00	0,00	0,00	1.502.447,33	10.616,73	163.086,73
ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	1.846.359,74	0,00	0,00	0,00	1.875.338,41	28.978,67	148.190,93
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.352.403,16	0,00	0,00	0,00	2.385.211,77	32.808,61	265.951,18
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	3.192.358,94	0,00	0,00	0,00	3.203.473,65	11.114,71	65.846,62
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FUNDO INVESTIMENTO	0,00	972.000,00	0,00	0,00	975.562,97	3.562,97	3.562,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
EM COTAS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR					13.921.656,98	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	9.162.515,44	0,00	0,00	0,00	9.231.208,83	68.693,39	447.904,17
					9.231.208,83	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRDESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	8.355.029,88	0,00	0,00	0,00	8.198.735,48	-156.294,40	348.010,82
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	0,00	900.000,00	0,00	0,00	898.473,87	-1.526,13	-1.526,13
					9.097.209,35	0,00	0,00

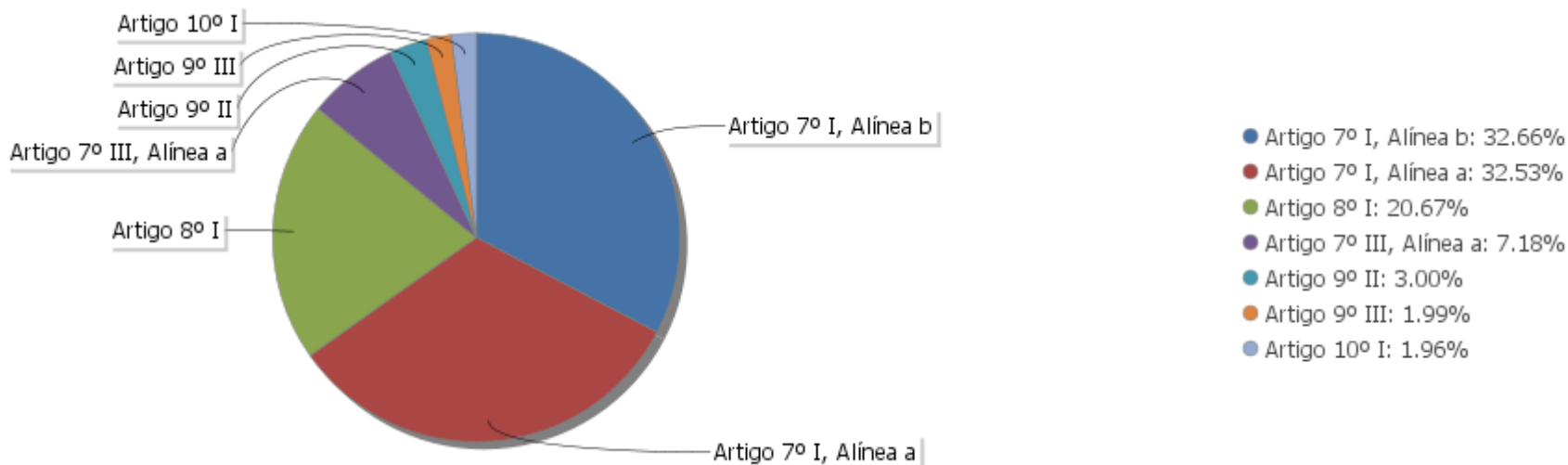
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

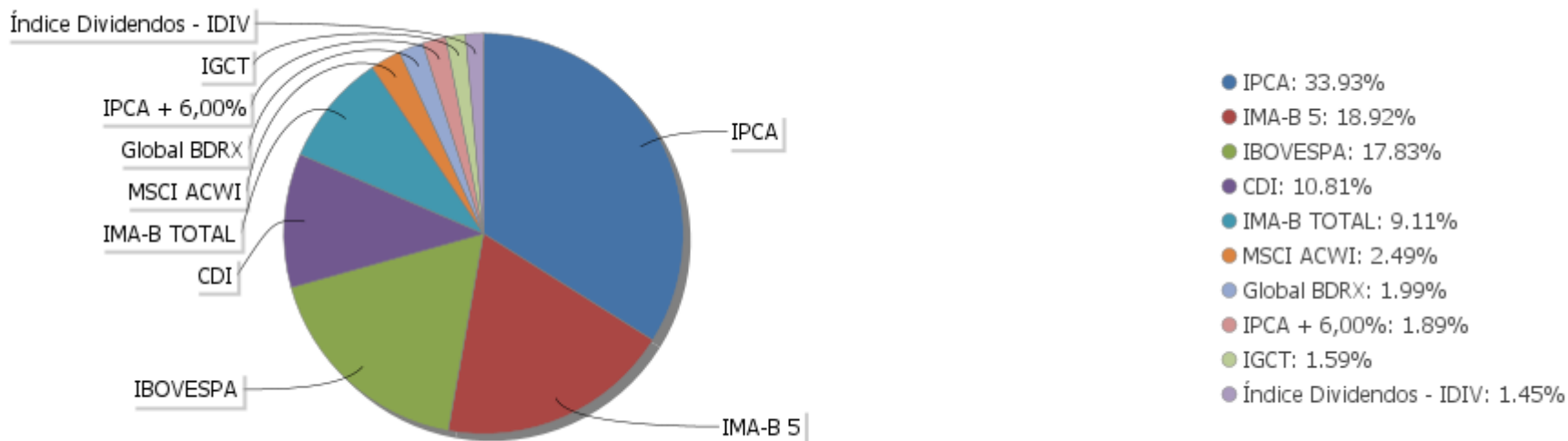
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	259.454.895,67	55,93	259.454.895,67	55,93
de 31 a 365 dias	53.519.177,68	11,54	312.974.073,35	67,47
acima de 365 dias	150.894.650,62	32,53	463.868.723,97	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

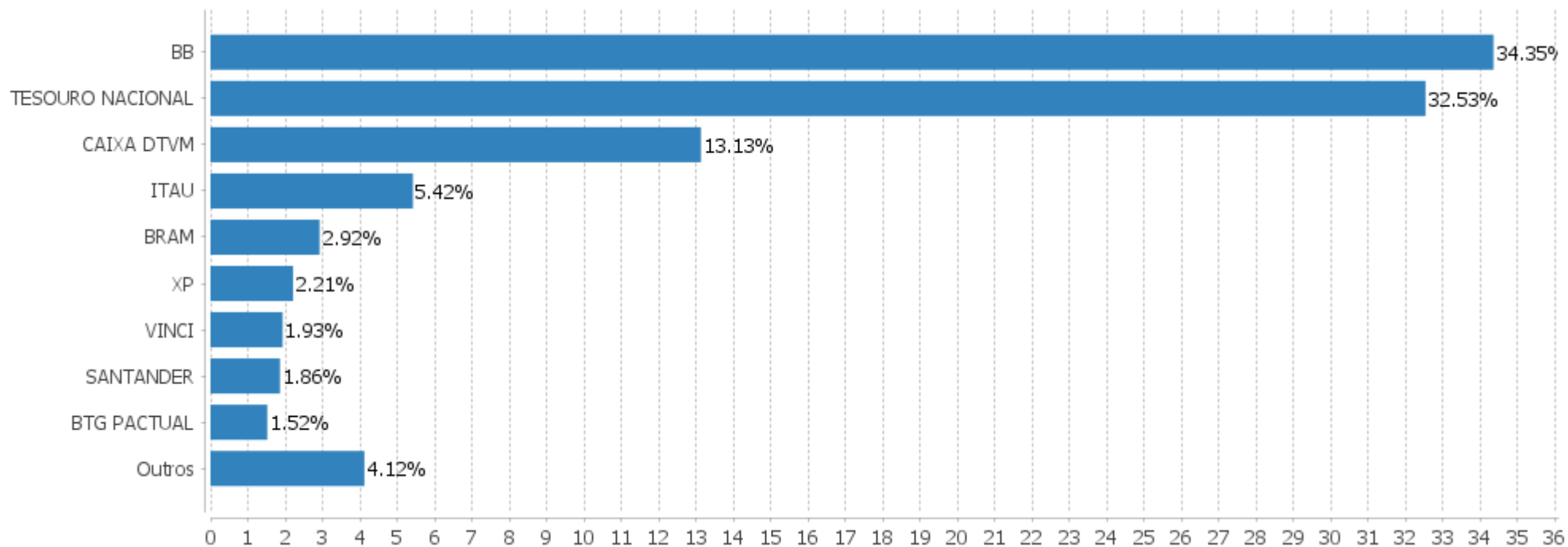


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,88	-0,73											1,14
IPCA + 5,17%	0,97	1,20											2,19
p.p. indexador	0,90	-1,93											-1,05
2022	0,17	-0,01	2,84	-1,90	0,83	-2,46	1,48	1,76	-0,00	2,64	-1,20	-0,34	3,70
IPCA + 5,04%	0,95	1,39	2,06	1,44	0,90	1,08	-0,27	0,09	0,12	0,98	0,80	1,05	11,10
p.p. indexador	-0,78	-1,40	0,79	-3,34	-0,08	-3,55	1,75	1,67	-0,12	1,66	-2,01	-1,40	-7,39
2021	-0,97	-1,44	0,98	1,41	1,79	0,28	-1,10	-1,35	-1,63	-2,54	1,17	0,89	-2,61
IPCA + 5,47%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,06
p.p. indexador	-1,64	-2,69	-0,45	0,68	0,51	-0,70	-2,53	-2,69	-3,24	-4,22	-0,21	-0,33	-18,66
2020	0,55	-1,24	-8,46	2,27	2,48	2,56	3,01	-0,97	-1,72	-0,22	3,95	4,23	5,91
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,16	-1,90	-9,03	2,12	2,41	1,82	2,13	-1,69	-2,84	-1,57	2,61	2,37	-4,74
2019	3,10	0,22	0,40	1,09	1,95	2,61	1,40	0,25	1,73	1,86	-0,47	2,58	17,98
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	2,27	-0,67	-0,79	0,03	1,31	2,16	0,68	-0,37	1,28	1,23	-1,45	0,94	7,39
2018	2,04	0,65	1,18	0,36	-2,44	-0,16	2,01	-0,78	0,83	4,35	0,82	1,33	10,51
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,24	-0,09	0,61	-0,35	-3,33	-1,92	1,17	-1,23	-0,10	3,38	0,57	0,72	0,59
2017	1,65	1,97	1,08	0,59	-0,38	0,69	2,77	1,61	1,69	-0,02	-0,21	1,35	13,52
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,76	1,22	0,29	0,04	-1,21	0,44	2,04	0,89	1,07	-0,93	-0,95	0,44	4,47

Performance Sobre a Meta Atuarial

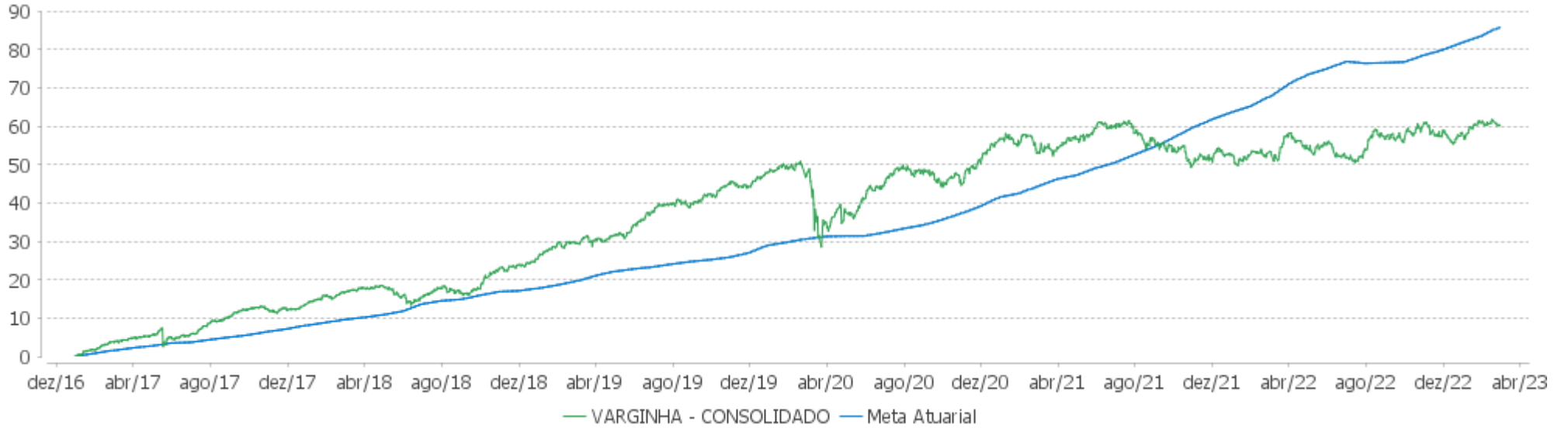
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	36	48,65
Meses abaixo - Meta Atuarial	38	51,35
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,35	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-8,46	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,79	3,26	-2,47	4,56
06 meses	2,21	5,24	-3,03	5,86
12 meses	4,72	10,92	-6,20	6,01
24 meses	4,66	29,26	-24,61	6,08
36 meses	8,94	43,80	-34,86	8,70
48 meses	23,52	58,47	-34,95	7,87
60 meses	37,33	74,52	-37,19	7,30
Desde 30/12/2016	60,12	93,25	-33,13	6,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

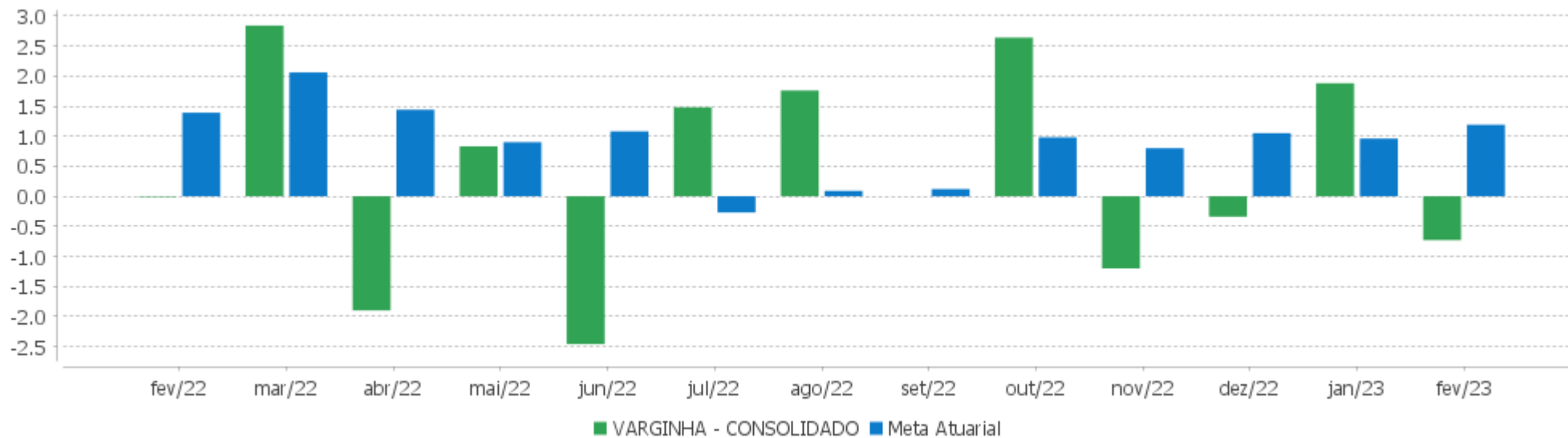


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150830 (6,280000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,15	2,22 0,85	3,14 1,14	5,07 2,34	8,99 3,39		
NTN-B 150535 (5,819800%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,15 0,78	3,03 1,03	4,85 2,12	8,62 3,02	20,03 3,30	25,59 2,79
NTN-B 150850 (5,972000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,13	2,17 0,80	3,07 1,06	4,92 2,19	8,74 3,14	20,26 3,53	25,92 3,12
NTN-B 150545 (5,786500%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,11	2,15 0,77	3,02 1,01	4,83 2,10	8,62 3,02		
NTN-B 150535 (6,100000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,14	2,19 0,82	3,10 1,09	4,98 2,26	8,83 3,23		
NTN-B 150824 (6,783000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,18	2,30 0,92	3,26 1,26	5,31 2,58	9,51 3,91		
NTN-B 150832 (6,295100%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,15	2,22 0,85	3,14 1,14	5,08 2,35	8,99 3,39		
NTN-B 150545 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,13	2,18 0,81	3,08 1,07	4,94 2,22	8,77 3,17		
NTN-B 150545 (6,160000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,14	2,20 0,83	3,11 1,11	1,95 -0,78	5,68 0,09		
NTN-B 150850 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,13	2,18 0,81	3,08 1,07	4,94 2,22	8,77 3,17		
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,16 0,79	3,05 1,04	4,88 2,15	8,68 3,09	20,17 3,44	25,80 3,00
NTN-B 150535 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,15 0,78	3,03 1,03	4,85 2,13	8,63 3,03		
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,16 0,78	3,04 1,03	4,78 2,06	8,59 2,99	20,07 3,34	25,71 2,91
NTN-B 150545 (5,895000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,16 0,79	3,05 1,04	4,88 2,16	8,69 3,09		
NTN-B 150824 (6,941000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,19	2,32 0,95	3,30 1,29	5,39 2,66	9,66 4,06		
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,26 -0,02	1,22 -0,06	0,98 -0,10	2,84 -0,18	7,75 -0,19	8,45 -0,48	11,50 -0,88
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,39	2,78	3,73	5,76	11,45	18,22	25,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,04	-0,06	-0,11	-0,12	-0,40	-0,79
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,92 100,34	2,04 99,66	3,13 98,03				
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,97 106,08	1,92 93,45	2,81 87,93	5,06 78,46	10,22 78,62	15,07 77,77	17,36 78,18
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,91 -0,35	2,43 0,11	3,41 -0,07	6,59 0,90	12,46 0,55	19,86 -11,30	27,66 -18,49
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,40 -0,01	2,79 -0,03	3,73 -0,06	5,73 -0,15	11,31 -0,26	17,99 -0,63	25,00 -1,01
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,98 0,14	1,63 0,26	2,41 0,41	4,63 1,90	10,13 4,54	13,25 -3,48	
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,27 -0,01	1,26 -0,02	1,04 -0,05	2,90 -0,12	7,68 -0,26	8,38 -0,55	11,52 -0,87
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,85 93,00	1,99 96,86	3,13 97,93	6,42 99,60	13,03 100,24	19,82 102,28	22,25 100,19
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,85 92,66	1,89 92,30	2,95 92,15	5,94 92,17	11,87 91,35	16,92 87,32	18,40 82,84
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,87 94,39	1,91 93,04	3,08 96,23	5,74 88,99	12,44 95,68	21,11 108,91	24,71 111,27
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,41 1,08	-3,30 1,08	-5,92 0,79	-6,67 -2,48	-6,62 0,64	-6,97 -2,33	-5,33 -6,06
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-7,48 0,01	-3,85 0,53	-6,33 0,38	-6,03 -1,84	-1,59 5,67	-10,03 -5,39	-6,86 -7,59
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-6,89 0,60	-3,99 0,38	-6,58 0,14	-8,46 -4,27	-11,74 -4,48	-23,02 -18,38	-16,60 -17,33
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-9,10 -1,61	-5,25 -0,87	-9,65 -2,93	-15,70 -11,51	-18,03 -10,78	-23,37 -18,74	-39,08 -39,81
BB AÇÕES AGRO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,21 4,29	-2,37 2,01	-4,94 1,78	-5,81 -1,62	-3,69 3,57	7,10 11,73	
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-6,28 1,27	-2,98 -0,87	-5,33 -1,64	-2,94 -2,10	-2,57 -7,62	2,31 -12,39	2,12 -8,52
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,90 0,59	-3,79 0,58	-6,15 0,56	-2,94 1,26	-5,87 1,39	-10,37 -5,74	-19,84 -20,57
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,66 1,84	-2,43 1,94	-3,96 2,75	-8,10 -3,91	1,55 8,81	-1,92 2,71	-9,43 -10,16
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-7,34	-4,24	-6,62	-7,40	-10,52	-1,82	3,98

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,16	0,13	0,10	-3,21	-3,27	2,81	3,25
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,29	-1,93	-4,93	-6,11	-9,07	-34,17	-27,40
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,27	-3,80	-7,46	-7,32	-10,14	-15,75	-19,17
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,47	-3,44	-8,16	-8,70	-13,51	-14,46	-13,61
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,70	-4,43	-7,51	-9,69	-8,49	-8,78	-1,93
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,37	-2,86	-4,61	-8,39	-12,30	-18,97	-22,46
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,44	-3,86	-6,42	-5,48	-6,65	-6,34	3,54
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-6,91	-3,78	-5,83	-4,46	-6,37	-10,56	-7,61
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-8,08	-1,93	-4,74	-10,72	-10,58	-19,78	-20,57
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-0,59	2,44	1,98	-6,53	-3,32	-15,14	-21,30
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-7,74	-4,40	-6,90	-5,59	-8,95	-7,83	-2,88
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-0,08	-0,08	-0,13	-0,44	-0,81	-1,69	-2,80
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,75	5,10	0,06	0,40	-10,41	-10,52	51,00
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FUNDO INVESTIMENTO EM COTAS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-0,40	-0,47	-1,05	-0,13	-0,81	-2,57	-4,73
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FUNDO INVESTIMENTO EM COTAS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	1,23	-1,08	-0,41	2,28	26,66	43,82	
ITAU AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI Var. MSCI ACWI p.p.	2,15	-4,78	1,51	-0,88	35,41	53,68	
ITAU AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI Var. MSCI ACWI p.p.	1,57	8,58	9,18	27,61	4,37	0,03	51,07
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	2,49	4,87	11,10	24,45	13,12	9,89	9,06
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	0,65	0,39	1,30	5,00	-1,86	-0,07	42,44
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,57	-3,31	3,22	1,84	6,89	9,79	0,43
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	0,35	2,10	2,30	5,19	-5,46	-8,90	
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI Var. MSCI ACWI p.p.	1,27	-1,61	4,23	2,03	3,29	0,96	
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI Var. MSCI ACWI p.p.	-1,57	1,56	1,99	4,73	3,23	17,89	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-0,65	-2,15	3,91	1,57	11,98	27,75	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	0,71	12,18	4,39	-11,13	-36,72	-59,34	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,63	8,47	6,32	-14,29	-27,97	-49,48	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,39	12,55	8,94	3,74	-16,89	-39,33	19,72
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,13	10,23	5,46	-1,95	-28,80	-70,49	-26,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,42 7,07	0,39 4,77	1,45 8,16	4,10 8,29	14,98 22,24	21,58 26,22	22,06 21,33
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	-1,87 -203,74	4,43 216,05	-0,70 -22,00	4,42 68,65	-1,46 -11,22	17,17 88,61	45,73 205,89
VARGINHA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,04% p.p.	-0,73 -1,93	1,14 -1,05	0,79 -2,48	2,21 -3,08	4,72 -6,32	4,66 -24,45	8,94 -33,81
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST ACOES FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BB AÇÕES AGRO FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+2	Será devida taxa de performance de 20% (vinte por cento), com base no resultado do FUNDO, sobre a rentabilidade que exceder 100% da variação do índice BOVESPA, calculada e provisionada diariamente nos dias considerados úteis, após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.	
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI						
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du	-	1,50
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	2,50
ITAU AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	D+0	D+1	D+1	D+5 du		
ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	D+1 du	D+0	D+22 du	D+24 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE	0,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					EQUIVALENTE A 10% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA B3.	
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	0,50
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	-	3,00
SANTANDER RF ATIVO FIC	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FUNDO INVESTIMENTO EM COTAS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	D+3	D+3	D+3	D+5		
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES						
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO			D+9	D+10	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
VINCI MOSAICO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	-	1,97
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	D+1 du	D+0	D+60	D+62	-	0,97
XP INVESTOR 30 FIC FIA	D+0	D+0	D+30	D+32	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,98	2,09	3,30	6,49	12,81	17,61	21,23	29,14	38,03
IRF-M 1+	0,79	1,51	3,16	4,25	9,06	7,22	10,24	25,91	40,07
IRF-M TOTAL	0,86	1,71	3,21	4,93	10,13	10,66	13,99	27,51	40,19
IMA-B 5	1,41	2,82	3,79	5,87	11,57	18,62	26,01	41,34	55,61
IMA-B 5+	1,17	-0,11	-1,30	0,52	4,86	0,42	1,37	23,71	45,02
IMA-B TOTAL	1,28	1,28	1,08	3,02	7,94	8,94	12,38	32,61	51,33
IMA-GERAL TOTAL	1,03	1,74	2,52	4,81	10,51	13,70	17,46	30,71	43,72
IDKA 2	1,62	3,08	4,36	6,05	11,25	18,71	26,96	41,17	55,55
IDKA 20	0,79	-3,83	-7,02	-4,75	-2,27	-14,73	-16,36	6,39	31,39
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,30

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73	9,78	22,94
IBRX 100	-7,59	-4,34	-6,85	-4,76	-8,23	-5,60	0,93	12,19	26,64
IBRX 50	-7,54	-4,41	-6,85	-3,59	-7,74	-3,34	4,52	11,43	23,50
SMALL CAP	-10,52	-7,90	-10,68	-16,48	-20,21	-30,84	-29,32	-4,09	7,17
Índice Consumo - ICON	-9,78		-12,01	-20,80	-30,44	-45,20	-44,63	-25,38	-25,80
Índice Dividendos - IDIV	-7,55	-2,11	-3,69	-0,84	5,04	14,70	10,65	34,58	57,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-0,54	3,21	-4,28	0,94	-8,25	-1,90	55,57	98,62	134,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,45	-2,05	-2,05	-5,64	2,45	-2,71	-5,24	15,36	21,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,92	3,71	-1,93	3,17	-8,75	-9,86	42,01	74,04	94,86

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,84	1,37	2,00	2,73	5,60	16,73	22,79	27,71	32,68
INPC	0,77	1,23	1,93	2,47	5,47	16,86	24,12	28,99	34,07
IGPM	-0,06	0,15	0,60	-1,88	1,86	18,28	52,51	62,91	75,30
SELIC	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,31

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,12	2,01	2,99	4,71	9,80	26,26	38,06	49,31	61,33
IPCA + 5,00%	1,19	2,16	3,23	5,20	10,85	28,69	42,07	55,11	69,21
IPCA + 5,50%	1,23	2,24	3,36	5,45	11,38	29,92	44,10	58,08	73,26
IPCA + 5,89%	1,25	2,30	3,45	5,64	11,79	30,89	45,70	60,42	76,48
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15	61,08	77,39
INPC + 4,00%	1,05	1,87	2,92	4,45	9,67	26,39	39,56	50,81	63,02
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73	62,70	79,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1582	02/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	547,87	223,01946000	2,4566017740
1601	02/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.100,00	2.076,03855600	2,4566017740
1579	03/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	127,16	0,00	51,73832800	2,4577523610
1600	03/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.789,96	4.797,04960800	2,4577523610
1584	06/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	206.151,93	0,00	83.839,34769200	2,4588923420
1577	06/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.534.581,30	0,00	1.030.781,72911700	2,4588923420
1585	07/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	19.600,65	0,00	7.967,62654500	2,4600362340
1578	07/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.376.384,68	0,00	559.497,72648700	2,4600362340
1603	09/02/2023	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	41.406,12	0,00	35.032,92778100	1,1819200570
1583	09/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	41.201,89	16.732,81839300	2,4623401170
1599	09/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.936,67	1.192,63377900	2,4623401170
1589	10/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	286.000,00	116.095,47249000	2,4634896940
1587	10/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	286.000,00	0,00	103.960,96503900	2,7510325620
1592	10/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	282.609,79	0,00	114.719,29056000	2,4634896940
1602	10/02/2023	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	300.000,00	12.491,36930500	24,0165823830
1581	13/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.190.000,00	1.700.040,79919400	2,4646467320
1574	13/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.190.000,00	0,00	1.522.323,14956200	2,7523722550

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1605	15/02/2023	TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	1.872.818,72	0,00	18.054,55332749	103,7311024000
1586	16/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	60.427,52	0,00	24.483,16235500	2,4681256090
1598	16/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.118,88	2.479,16069500	2,4681256090
1597	17/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.254,68	913,09559500	2,4692704830
1608	17/02/2023	TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,00	972.000,00	9.360,80484685	103,8372251000
1596	23/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	440,72	178,31315500	2,4716067660
1604	24/02/2023	SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FUNDO INVESTIMENTO EM COTAS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	972.000,00	0,00	6.975,37964117	139,3472542000
1595	24/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	250,00	101,10003400	2,4727983770
1610	24/02/2023	TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,00	900.000,00	8.653,98210458	103,9983662000
1588	27/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	188.699,11	0,00	76.273,89150700	2,4739672550
1591	27/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.914.692,72	1.054.635,12426400	2,7636977500
1576	27/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	257.886,06	0,00	104.239,88412800	2,4739672550
1575	27/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.938.975,93	1.063.421,61692600	2,7636977500
1594	27/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	63.365,56	25.612,93399200	2,4739672550
1606	27/02/2023	VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	900.000,00	0,00	723.659,69179300	1,2436785000
1590	28/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	188.699,11	76.237,19985100	2,4751579330
1580	28/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	227.901,09	92.075,37303400	2,4751579330
1593	28/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.590,67	2.258,71243400	2,4751579330
Total			13.188.693,04	13.057.865,75		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 11.375.759,19

Value-At-Risk: 2,45%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VARGINHA - CONSOLIDADO		2,45	2,45			463.868.723,97	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,77%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,819800%)		0,17	-0,00	0,19			5.016.271,36	1,08
NTN-B 150535 (5,831000%)		0,17	-0,00	0,19			10.440.922,87	2,25
NTN-B 150535 (6,100000%)		0,17	-0,00	0,19			10.212.889,84	2,20
NTN-B 150545 (5,786500%)		0,17	-0,00	0,19			10.564.586,89	2,28
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,17	-0,00	0,19			10.189.937,93	2,20
NTN-B 150545 (5,895000%)		0,17	-0,00	0,19			10.430.087,74	2,25
NTN-B 150545 (6,020000%)		0,17	-0,00	0,19			10.278.274,60	2,22
NTN-B 150545 (6,160000%)		0,24	0,00	0,24			10.112.119,07	2,18
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,28	-0,00	0,29			10.521.013,90	2,27
NTN-B 150824 (6,783000%)		0,17	-0,00	0,19			10.028.257,98	2,16
NTN-B 150824 (6,941000%)		0,17	-0,00	0,19			10.407.618,58	2,24
NTN-B 150830 (6,280000%)		0,17	-0,00	0,19			12.041.085,51	2,60
NTN-B 150832 (6,295100%)		0,17	-0,00	0,19			10.332.670,20	2,23
NTN-B 150850 (5,972000%)		0,28	0,00	0,29			10.191.310,54	2,20
NTN-B 150850 (6,020000%)		0,17	-0,00	0,19			10.127.603,61	2,18
Sub-total	0,19	0,13	-0,00		0,31	0,98	150.894.650,62	32,53

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES		0,01	0,00	0,01			4.140,01	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		1,37	0,02	1,36			6.508.045,95	1,40
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,04	0,21	0,05			39.326.459,79	8,48
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,10	0,02	0,03			2.922.241,27	0,63
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,35	0,09	0,01			42.065.860,45	9,07
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,36	0,10	0,02			45.695.021,54	9,85
BB PREV RF IPCA		0,80	0,00	0,80			6.387.471,76	1,38
SANTANDER RF ATIVO FIC		0,78	0,01	0,78			8.607.509,27	1,86
Sub-total	2,90	1,70	0,44		0,13	1,30	151.516.750,04	32,66

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			29.210.849,26	6,30
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			356.682,81	0,08
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,26	0,00	0,26			3.757.203,17	0,81
Sub-total	0,26	0,03	0,00		-0,25	0,85	33.324.735,24	7,18

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,78%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		11,11	0,10	3,91			4.508.966,59	0,97
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		9,96	0,03	1,49			1.629.718,87	0,35
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		11,18	0,17	1,83			7.487.375,33	1,61
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		11,54	0,18	0,18			7.383.119,38	1,59
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		10,89	0,03	6,05			1.237.129,85	0,27
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		9,74	0,13	5,30			7.069.858,98	1,52
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		10,96	0,15	2,94			6.705.907,12	1,45
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		11,39	0,07	3,02			2.835.638,04	0,61
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		9,58	0,12	2,73			6.429.910,44	1,39
OCCAM FIC FIA		8,70	0,12	2,91			7.038.536,99	1,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		13,09	0,17	5,47			6.186.791,87	1,33
XP INVESTOR 30 FIC FIA		12,95	0,18	5,64			6.899.151,51	1,49
VINCI MOSAICO FIA		12,99	0,14	4,96			5.230.496,63	1,13
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		10,92	0,14	1,39			6.358.870,45	1,37
BRADESCO F I A SELECTION		9,91	0,11	1,91			5.331.007,87	1,15
BB AÇÕES AGRO FIC FI		8,87	0,03	5,75			1.900.180,46	0,41
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		12,74	0,15	5,01			5.804.861,21	1,25
ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI		11,81	0,14	3,75			5.844.991,32	1,26
Sub-total	16,37	10,78	2,16		-0,48	-6,90	95.882.512,91	20,67

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,98%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FUNDO INVESTIMENTO EM COTAS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR		5,18	0,00	13,08			975.562,97	0,21
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI		6,92	-0,00	9,85			2.118.456,04	0,46
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		9,89	-0,02	9,47			1.861.166,81	0,40
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		23,93	-0,01	20,91			1.502.447,33	0,32
ITAU AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI		13,37	-0,02	8,65			1.875.338,41	0,40
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		14,70	-0,03	14,70			2.385.211,77	0,51
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		11,20	-0,03	11,20			3.203.473,65	0,69
Sub-total	19,52	10,39	-0,11		-0,03	0,42	13.921.656,98	3,00

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		11,72	-0,07	1,42			9.231.208,83	1,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	21,06	11,72	-0,07		-0,01	0,75	9.231.208,83	1,99

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,34%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO		1,42	0,00	10,37			898.473,87	0,19
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		10,37	0,03	10,37			8.198.735,48	1,77
Sub-total	16,13	9,34	0,03		-0,17	-1,88	9.097.209,35	1,96